

DAFTAR TABEL

Tabel 2. 1 Kajian Penelitian Terkait.....	11
Tabel 2. 2 Nilai λ dan Transformasi yang Sesuai	21
Tabel 2. 3 Tolak Ukur Nilai MAPE	29
Tabel 3. 1 Data Harga Saham PT Unilever Indonesia	32
Tabel 3. 2 Penjelasan Variabel Data Penelitian	33
Tabel 4. 1 Statistik Deskriptif Data Harga Saham PT Unilever Indonesia	39
Tabel 4. 2 Hasil Uji Stasioneritas Data Harga Saham.....	43
Tabel 4. 3 Hasil Uji Stasioneritas Data Transformasi Logaritma & Differencing.	45
Tabel 4. 4 Kandidat Model ARIMA dan Estimasi Parameter	46
Tabel 4. 5 Hasil Uji Diagnostik Residual Model ARIMA	48
Tabel 4. 6 Hasil Estimasi Model ARIMA(2,1,3).....	48
Tabel 4. 7 Hasil Uji Diagnostik untuk Model ARIMA(2,1,3).....	50
Tabel 4. 8 Hasil Uji LM Model ARIMA(2,1,3).....	51
Tabel 4. 9 Hasil Evaluasi Model ARCH-GARCH.....	52
Tabel 4. 10 Hasil Evaluasi Model GJR-GARCH	53
Tabel 4. 11 Hasil Estimasi Model.....	54
Tabel 4. 12 Hasil Uji Signifikansi Model ARCH-GARCH	54
Tabel 4. 13 Hasil Uji Diagnostik GARCH(1,2)-sstd	55
Tabel 4. 14 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi GARCH(1,2).....	57
Tabel 4. 15 Perbandingan Harga Aktual dan Prediksi GARCH-Filter Kalman	60
Tabel 4. 16 Evaluasi Kesalahan Prediksi	62
Tabel 4. 17 Peramalan Harga Saham PT Unilever Indonesia	63
Tabel 4. 18 Statistik Deskriptif Peramalan Harga Saham PT Unilever Indonesia	63
Tabel 4. 19 Validasi Harga Saham PT Unilever Indonesia dengan GARCH(1,2) dengan Filter Kalman Januari 2025	65